

# 融通月月添利定期开放债券型证券投资基金

基金管理人：融通基金管理有限公司  
基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2017年3月30日

**§ 1 重要提示**

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。

本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签章。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据融通月月添利定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同规定，于2017年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要除年度报告正文投资、收益了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告财务数据已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2016年1月1日起至2016年1月31日止。

**§ 2 基金简介**

2.1 基金基本情况

基金简称	融通月月添利定期开放债券
基金主代码	000437
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年5月20日
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期基金份额总额	1,359,100,426.01份
基金合同存续期间	不长期
下一级基金的基金简称：	融通月月添利定期开放债券A
下一级基金的基金代码：	000437
报告期末的份额总额	1,261,112,998.93份

2.2 基金产品说明

投资目标 在严格控制风险的基础上，追求基金资产的长期稳健增值，力争收益率高于业绩比较基准的投资回报。

投资策略 本基金主要通过投资固定收益类品种，不追求高风险、高收益，以追求本金安全、实现稳定的收入为目标，通过久期配置、利率预期、信用评价、资产配置等方法，在严格控制风险的前提下，精选具有较高流动性的券种，以获取稳定收益。

投资基准 本基金的业绩比较基准为一年期定期存款税后收益率。

风险特征 本基金是一只债券型基金，属于较低风险、收益稳定的低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

姓名	职务	任本基金的基金经理 (基金总份额)	任本基金的基金经理 (基金总份额)	任本基金的基金经理 (基金总份额)
张一格	本基金的基金经理，固定期限 经理。	2016年8月 24日	10	融通基金管理有限公司
王海	本基金的基金经理。	2016年8月 24日	13	融通基金管理有限公司
汪琪	本基金的基金经理。	2016年9月 6日	4	融通基金管理有限公司

2.4 信息披露方式

登载基金半年报正文的管理人互联网网址 http://www.rtfund.com

基金年度报告备置地 基金管理人处、基金托管人处

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 利润回报指标	2016年		2015年		2014年	
	年初至报告期期末	报告期	年初至报告期期末	报告期	年初至报告期期末	报告期
融通月月添利定期开放债券A	53,941,405.33	841,021.06	63,122,691.24	27,962.09	10,430.71	7,612.62
本期已实现收入	-14,426,947.16	-3,201,990.00	107,361,265.24	60,237.48	17,026.00	14,224.23
已实现的基金利润	-0,013.06	-0,147.77	0.1249	0.1302	0.0213	0.0200
本期基金分红	-0.05%	-0.06%	12.73%	12.23%	2.10%	2.00%
3.1.2 利润系数	0.0176	0.0180	0.0176	0.0176	0.0176	0.0176
3.1.3 利润总额	0.0176	0.0180	0.0176	0.0176	0.0176	0.0176
3.1.4 利润	0.0176	0.0180	0.0176	0.0176	0.0176	0.0176
注：(1) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计价	费后实际收益水平要低于所列数字；					
(2) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；						
(3) 期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润-期末基金份额总额。其中期末可供分配利润如果未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。						

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

融通月月添利定期开放债券A

阶段	份额净值增长 率	份额净值增 长率标准差	业绩比较基 准收益率	业绩比较基 准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	-3.04%	0.25%	0.38%	0.00%	-4.02%	0.22%
过去六个月	-1.40%	0.17%	0.36%	0.00%	-2.15%	0.17%
过去一年	-0.05%	0.14%	1.50%	0.00%	-2.00%	0.14%
自基金合同生 效之日起至今	1.46%	0.14%	4.62%	0.00%	0.94%	0.14%

融通月月添利定期开放债券B

阶段	份额净值增 长率	份额净值增 长率标准差	业绩比较基 准收益率	业绩比较基 准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	-3.07%	0.25%	0.38%	0.00%	-4.05%	0.23%
过去六个月	-1.40%	0.18%	0.36%	0.00%	-2.18%	0.18%
过去一年	-0.05%	0.14%	1.50%	0.00%	-2.03%	0.15%
自基金合同生 效之日起至今	1.49%	0.14%	4.62%	0.00%	0.95%	0.14%

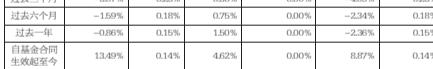
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金合同生效以来，本基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

融通月月添利定期开放债券A



融通月月添利定期开放债券B



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

融通月月添利定期开放债券A



融通月月添利定期开放债券B



注：本基金合同生效日为2014年8月29日，合同生效当年按实际存续期计算，按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本报告期内，本基金未进行利润分配。

单位：人民币元

年度	每10份基金 份额分红数	现金形式分红总额	再投形式分红总额	年度利润分配合计	备注
2016	0.0300	47,879,006.06	5,792,389.30	53,471,395.36	-
2015	0.0300	71,006,171.69	4,374,476.00	75,380,647.69	-
2014	-	-	-	-	-

注：本基金于2016年4月20日实施利润分配，以2016年3月31日的可分配收益为基准，融通月月添利定期开放债券B每10份基金份额派发红利0.05元。

单位：人民币元

年度	每10份基金 份额分红数	现金形式分红总额	再投形式分红总额	年度利润分配合计	备注
2016	1.3000	110,774,324.65	5,796,022.00	124,571,146.65	-
2015	-	-	-	-	-
2014	-	-	-	-	-

注：本基金于2016年4月20日实施利润分配，以2016年3月31日的可分配收益为基准，融通月月添利定期开放债券A每10份基金份额派发红利0.05元。

单位：人民币元

年度	每10份基金 份额分红数	现金形式分红总额	再投形式分红总额	年度利润分配合计	备注



<tbl\_r cells="6" ix="3" max